

## 店頭FX取引に係るリスク情報

計測日時: 2020年5月29日

イ. 未カバー率は、23:00、25:00、27:00の3時点のうち未カバーポジションの額が最大となる時点で計測

ロ. カバー取引の状況は、23:00、25:00、27:00の3時点のうちカバー取引先における建玉の合計額が最大となる時点で計測

ハ. 平均証拠金率は、取引終了時点で計測

イ. 未カバー率 > カバーされていないポジションは、為替相場の変動の影響を直接受けることになります。

$$\left[ \text{【計算式】 (未カバーポジション<sup>(注)</sup> / |顧客の買い建玉 - 顧客の売り建玉|) } \times 100 \right]$$

(注)顧客の建玉のうち、顧客の建玉同士で売り買いが対当しておらず、かつ、カバーされていない顧客の建玉

未カバー率
5.36%

ロ. カバー取引の状況 > カバー取引先が破綻した場合には、再構築コスト等が発生することになります。

$$\left[ \begin{array}{l} \text{【各区分の計算式】} \\ \text{【各区分のカバー取引先における買建玉と売建玉の合計 / 全カバー取引先における買建玉と売建玉の合計} \end{array} \right] \times 100$$

【 A 】	【 B 】	【 C 】	【 D 】
22.26%	21.60%	17.07%	15.44%
【 E 】	【 F 】	【 】	【 】
12.54%	11.10%	%	%

※カバー取引のシェアが高いものから順に記載しており、英字表記は特定のカバー取引先を指すものではありません。

※カバー取引先は全て、投資適格水準(BBB-以上、格付付与はS&Pグローバル・レーティングによる)となっております。

ハ. 平均証拠金率 > 証拠金率が低い場合には、顧客未収金リスクが大きくなります。

$$\left[ \text{【計算式】 実預託額 / (顧客の買い建玉 + 顧客の売り建玉) } \times 100 \right]$$

平均証拠金率
16.11%

(参考)

店頭FX取引を行う金融商品取引業者は、金融商品取引業等に関する内閣府令第117条第1項第28号の2の規定に基づき、特定通貨関連店頭デリバティブ取引(店頭FX取引)に係る上記リスク情報を開示することが義務付けられております。

以上